

Fecha de Publicación: 17 de julio de 2017

Fecha de Información: 13 de julio de 2017 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$2508.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	417.2	292.3	123.0	305.5	63.3	5.7	106.0
15-35	789.0	943.0	594.7	201.9	194.3	433.0	154.0
36-60	8.7	41.6	29.0	0.0	12.6	8.7	0.0
61-90	30.1	40.8	31.1	0.0	9.7	30.1	0.0
91-180	75.8	38.6	0.0	65.0	28.6	0.8	10.0
>180	60.8	75.0	15.0	0.0	25.0	25.8	35.0
Total	1381.7	1431.3	792.8	572.4	333.5	504.2	305.0

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5.0 %	5.0 %	4.7 %	4.8 %
15-35	4.8 %	4.5 %	4.7 %	4.6 %
36-60	-	4.8 %	4.1 %	4.7 %
61-90	-	4.7 %	4.5 %	4.6 %
91-180	4.6 %	4.8 %	4.5 %	4.6 %
>180	4.3 %	4.3 %	4.1 %	4.3 %
Total	4.8 %	4.6 %	4.6 %	4.6 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	10 al 14 de julio				17 al 21 de julio				24 al 28 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	46	93	3506	3380	75	107	3392	4067	21	100	4296	3991
Intragruppo y off-shore***	0	0	1712	1222	0	0	2369	1101	0	0	1892	1698
Otros	93	46	810	1417	107	75	496	1090	100	21	951	1449
Total	139	139	6028	6018	182	182	6257	6257	121	121	7139	7139

* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

¹ Datos provisionales.

² El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.